

MR2:内部モデル方式を適用して算出されたリスク・アセットの額の変動要因(三菱UFJ信託銀行・連結)

(単位:百万円)

項番	前四半期末:2019年9月末 当四半期末:2019年12月末	イ	ロ	ハ	ニ	ホ	ヘ
		バリュウ・ アツ・ リスク	ストレス・ バリュウ・ アツ・ リスク	追加的 リスク	包括的 リスク	その他	合計
1a	前四半期末におけるリスク・アセット	134,719	703,689	-	-		838,408
1b	前四半期末における自己資本比率規制上のリスク・アセット額への調整	3.23	3.37	-	-		3.35
1c	前四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	41,604	208,304	-	-		249,908
2	当四半期中の要因別の変動額	リスク量の変動	△ 1,777	△ 73,830	-	-	△ 75,608
3		モデルの更新又は変更	-	-	-	-	-
4		手法及び方針	-	-	-	-	-
5		買収及び売却	-	-	-	-	-
6		為替の変動	△ 138	2,551	-	-	2,413
7		その他	△ 4,208	△ 43,936	-	-	△ 48,143
8a	当四半期末の算出基準日における内部モデル方式の算出額	35,480	93,089	-	-		128,569
8b	当四半期末における自己資本比率規制上のリスク・アセット額への調整	3.57	5.96	-	-		5.30
8c	当四半期末におけるリスク・アセット	126,996	554,851	-	-		681,848